

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU

RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	31 Julio 19	01 Ago 19	02 Ago 19
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	1 861,3	2 217,0	4 273,1
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones			
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR			
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)			
Propuestas recibidas	50,0	50,0	
Plazo de vencimiento	212,0	199,0	
Tasas de Inter. Mínima	552,4	369,4	
Máxima	2,40	2,38	
Promedio	2,43	2,43	
Saldo	2,41	2,40	
Saldo	26 644,4	26 719,4	24 640,3
Próximo vencimiento de CD BCRP el 8 de agosto de 2019	2 079,1	2 079,1	952,1
Vencimiento de CD BCRP del 5 al 9 de agosto del 2019	2 079,1	2 079,1	952,1
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)			
Propuestas recibidas	2000,0	2000,0	300,0
Plazo de vencimiento	2900,0	2900,0	850,0
Tasas de Inter. Mínima	1,4	1,4	3,4
Máxima	2,75	2,75	2,91
Promedio	3,01	3,01	2,91
Saldo	2,96	2,96	2,91
Saldo	7 110,0	8 610,0	6 660,0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 5 de agosto de 2019	500,0	2 250,0	1 200,0
Vencimiento de REPO BCRP del 5 al 9 de agosto del 2019	750,0	2 250,0	1 760,0
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter. Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	Aug 01, 2019	0,0
Próximo vencimiento de CDLD BCRP el	0,0	2 217,0	0,0
Vencimiento de CDLD BCRP del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
iv. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	300,0	50,0	0,0
Propuestas recibidas	566,5	199,0	
Plazo de vencimiento	1,4	369,4	
Tasas de Inter. Mínima	2,0	2,38	
Máxima	2,40	2,43	
Promedio	2,33	2,40	
Saldo	300,0	26 719,4	0,0
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo	300,0	2 079,1	0,0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 5 al 9 de agosto del 2019	300,0	2 079,1	0,0
v. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público			
Propuestas recibidas		2000,0	
Plazo de vencimiento		2900,0	
Tasas de Inter. Mínima		1,4	
Máxima		2,75	
Promedio		3,01	
Saldo	4 100,1	8 610,0	4 100,1
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 24 de octubre de 2019	500,0	2 250,0	500,0
Vencimiento de Coloc-TP del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	2 250,0	0,0
vi. Subasta de Certificados de Depósitos Reajustables del BCRP (CDR BCRP)			
Propuestas recibidas	0,0	0,0	0,0
Plazo de vencimiento	0,0	0,0	0,0
Tasas de Inter. Mínima	0,0	0,0	0,0
Máxima	0,0	0,0	0,0
Promedio	0,0	0,0	0,0
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de CDR BCRP	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de CDR BCRP del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
vii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter. Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	11 750,1	0,0	11 750,1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 26 de septiembre de 2019	600,0	0,0	600,0
Vencimiento de REPO del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
viii. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter. Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Expansión	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Expansión del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter. Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de Repo Sustitución	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de REPO Sustitución del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
x. Subasta de Swap Cambiario Venta del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter. Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	0,0	0,0
Próximo vencimiento de SC-Venta	0,0	0,0	0,0
Vencimiento de SC - Venta del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
xi. Subasta de Swap Cambiario Compra del BCRP			
Propuestas recibidas			
Plazo de vencimiento			
Tasas de Inter. Mínima			
Máxima			
Promedio			
Saldo	0,0	11 750,1	0,0
Próximo vencimiento de SC-Compra	0,0	600,0	0,0
Vencimiento de SC - Compra del 5 al 9 de agosto del 2019	0,0	0,0	0,0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Negociación del BCR			
i. Compras (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio			
ii. Ventas (millones de US\$)	0,0	0,0	0,0
Tipo de cambio promedio			
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)			
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público	0,0	0,0	0,0
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP			
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR			
ii. Compras de BTP			
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	1 561,3		4 573,1
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones			
a. Compra temporal de moneda extranjera (swaps).			
Comisión (tasa efectiva diaria)	0,0076%		0,0095%
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)			
Tasa de interés	3,30%	0,00%	3,30%
c. Crédito por regulación monetaria en moneda nacional			
Tasa de interés		0,0	
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	1 047,2		25,0
Tasa de interés	1,50%		1,50%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	514,1		4 548,1
a Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	7 851,9		7 768,1
b Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	5,1		5,1
c Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	2 498,6	0,0	2 414,6
d Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (*)	1,6	0,0	1,6
6. Mercado Interbancario y mercado secundario de CDBCRP			
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1 522,5	0,0	600,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio	2,75/2,80/2,75		2,75/2,75/2,75
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)			39,0
Tasas de Interés: Mínima / Máxima / Promedio			2,25/2,35/2,28
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV			
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)			
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)		0,0	
Plazo 2 años (monto / tasa promedio)			
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	30 Julio 19	0,0	01 Agosto 19
Flujo de la posición total = a + b.i - c.i + e + f + g	115,0		16,6
Flujo de la posición contable = a + b.i - c.i + e + f + g	74,5		-19,2
a. Mercado spot con el público	146,7		365,2
i. Compras	72,2		405,4
ii (-) Ventas	-28,8		-117,7
l. Pactadas	14,7	0,0	256,3
iii (-) Vencidas	43,5	0,0	274,0
b. Ventas forward y swap al público (con y sin entrega)	14,3	0,0	-1,8
i. Pactadas	17,1	0,0	664,5
ii (-) Vencidas	2,8	0,0	666,3
c. Operaciones cambiarias interbancarias		0,0	
i. Al contado	0,0	0,0	893,1
ii. A futuro	0,0	0,0	87,9
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-0,2	0,0	425,0
i. Compras	0,2	0,0	634,2
ii (-) Ventas	0,4	0,0	209,2
f. Efecto de Opciones	0,0	0,0	-0,5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0,0	0,0	3,1
h. Crédito por regulación monetaria en moneda extranjera			
Tasa de interés	11,0	4167,0	
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Datatec)		0,0000	3,3189
(*) Datos preliminares		0,0	